

## <<MATLAB与金融实验>>

### 图书基本信息

书名：<<MATLAB与金融实验>>

13位ISBN编号：9787509509678

10位ISBN编号：750950967X

出版时间：2008-12

出版时间：中国财政经济出版社一

作者：张骅月

页数：367

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## 前言

南开大学经济学科多年来一直在探讨如何适应改革开放、如何根据理论与实践的发展进行教学改革，包括教学理念与教学内容的更新、教学方式与教学方法的创新。

实验教学的内容和方法是教学改革多方面的具体体现。

南开大学也为经济学科实验课程教学的开设提供了重要的物质保证，在整合相关资源的基础上投资建设的实验教学中心成为经济学科各专业本科生、硕士生、博士生实验教学和实践教学基地，是经济学科教学、科研和社会服务重要的基础支撑。

经过多年的建设与探索，南开大学经济学实验教学中心逐步建立起与学科发展和人才培养目标相适应、比较科学的实验教学体系，同时组织实验课程教师开发适合于不同专业、不同教学层次的实验课程，并在课程中广泛引入了演示法、案例法、模拟法、仿真法、模块式沙盘规划法等教学方法。

经过数年的积累，实验课程教师在教学的过程中组织学生自主研发教学软件，将科研成果注入实验教学体系，从而使科研成果与教学内容相结合，也使教学软件有了自我更新的能力。

实验课程教材内容体现了实验课程教师多年来不断研究和实践的成果，也体现了南开大学经济学科对教学改革内容的探索。

目前，实验教学已经成为经济学教学的重要组成部分。

当然，无论是实验课程教材体系还是实验课程教学内容，都有待于根据理论与实践的发展，以及技术手段的提升不断更新和完善。

我们期待读者与同行的意见和建议。

## <<MATLAB与金融实验>>

### 内容概要

本书从应用角度出发，通过大量的金融实例，介绍如何应用MATLAB进行金融计算，重点、详细地介绍时间序列的建模，分析与时间序列的绘图，投资组合分析，金融衍生产品的定价与敏感度分析，固定收益证券计算及MATLAB与EXCEL和Word的相互结合，内容十分丰富，读者只需具备基本的计算机语言基础知识和基本的金融学知识即可顺利阅读大部分内容。

## 书籍目录

第1章 MATLAB简介 1.1 MATLAB概述 1.2 MATLAB产生的历史背景 1.3 MATLAB的语言特点  
1.4 MATLAB在金融行业中的应用第2章 MATLAB的数值计算 2.1 金融学中的矩阵函数 2.2 矩  
阵元素 2.3 矩阵的运算 2.4 向量运算 2.5 矩阵的输入 2.6 MATLAB的关系和逻辑运算 2.7  
插值与拟合 2.8 MATLAB的帮助功能 附录：MATLAB常用的数学函数 第3章 金融时间序列 3.1  
金融时间序列的创建 3.2 金融时间序列的使用 3.3 金融时间序列的运算 3.4 日期的处理和转换  
3.5 金融时间序列的用户图形界面 3.6 时间序列建模 附录：一、金融时间序列对象函数 二  
、GARCH工具箱函数第4章 投资组合分析 4.1 投资组合中的常用函数 4.2 投资组合的有效前沿  
4.3 积极的投资回报和有效前沿的跟踪误差第5章 金融衍生产品的定价模型 5.1 期权的类型 5.2  
布莱克-斯科尔斯模型 5.3 二叉树模型 5.4 证券类衍生产品 5.5 利率类衍生产品 5.6 树  
图结构 5.7 投资组合的管理 附录：金融衍生产品工具箱常用函数第6章 固定收益证券 6.1 现金  
流的分析与计算 6.2 固定收益证券产品 6.3 固定收益的敏感性 6.4 期限结构的计算 附录：固定收  
益工具箱常用的函数第7章 MATLAB绘图与金融数据的可视化 7.1 MATLAB的图形窗口 7.2 图形  
对象及其句柄 7.3 金融时间序列的绘图 7.4 MATLAB金融图表的Demo演示 7.5 金融时间序列绘  
图的修改第8章 蒙特卡罗方法 8.1 随机变量的生成 8.2 资产收益相关性的MC模拟 8.3 蒙特卡罗  
方法模拟期权定价 8.4 蒙特卡罗模拟等价鞅测度第9章 在Word环境下使用MATLAB 9.1  
Notebook操作基础 9.2 单元的使用 9.3 输出格式控制 9.4 MATLAB与EXCEL的数据连结 主要  
参考文献

章节摘录

插图：

## <<MATLAB与金融实验>>

### 编辑推荐

《MATLAB与金融实验》：南开大学经济类系列实验教材。

<<MATLAB与金融实验>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>